

Pemilihan portofolio dengan menggunakan metode cat swarm optimization = Portfolio selection using cat swarm optimization

Fadhilah Putri Syofyany, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=20431718&lokasi=lokal>

Abstrak

ABSTRAK

Investor melakukan investasi untuk mendapatkan imbal hasil yang besar dengan risiko minimum. Untuk mengoptimalkan imbal hasil dan risiko yang didapatkan dari investasi, investor dapat melakukan diversifikasi yang efisien. Salah satu bentuk diversifikasi yang efisien adalah dengan melakukan pemilihan portofolio. Pemilihan portofolio merupakan masalah optimisasi dalam pemilihan kombinasi aset yang dapat menghasilkan imbal hasil dan risiko yang optimal. Model yang digunakan dalam menyelesaikan masalah pemilihan portofolio pada skripsi ini adalah model standar Markowitz dengan diberikan kendala tambahan yaitu banyaknya aset yang diinvestasikan dan kendala batasan proporsi untuk masing-masing aset. Terdapat banyak metode yang bisa digunakan untuk menyelesaikan masalah pemilihan portofolio dengan model tersebut, salah satunya adalah metode Cat Swarm Optimization. Hasil implementasi pemilihan portofolio dengan menggunakan metode Cat Swarm Optimization berupa pasangan imbal hasil dan risiko beserta proporsi investasi untuk setiap aset. Hasil implementasi tersebut kemudian di analisis untuk melihat kinerja metode CSO dalam masalah pemilihan portofolio.

<hr>

ABSTRAK

The purpose of investments is to get high return with minimum risk. To optimize return and risk from investments, investors should diversify their assets efficiently. One such method is portfolio selection. Portfolio selection is an optimization problem in selecting asset combinations which produce an optimal risk and return. In this thesis, the model for solving the optimization problem is Markowitz standard model with some additional constraints. The constraints are the number of assets that are held in a portfolio and bounding assets proportion constraint. There are some methods to solve portfolio selection with this model. One of the methods is Cat Swarm Optimization. The implementation results from portfolio selection using Cat Swarm Optimization are some pairs of return and risk with their asset proportions. The results are analyzed to test the performance of Cat Swarm Optimization in portfolio selection.